勝つロジックを求めるトレーダーたちへ

ラリー・ウィリアムズ氏 公認 自動売買パッケージ

ラリー・ロボット

West Village Investment Co., Ltd.

ラリー・ロボットとは？

- パンローリング株式会社の全面協力により実現 !!
- West Village Investment 株式会社がトレード界の重鎮 **ラリー・ウィリアムズ**とタッグを組み、ラリー氏が著書の中で提供してきた投資戦略を完全プログラム化 !!
- 日本で唯一、**ラリー氏公認**の完全自動売買システム。

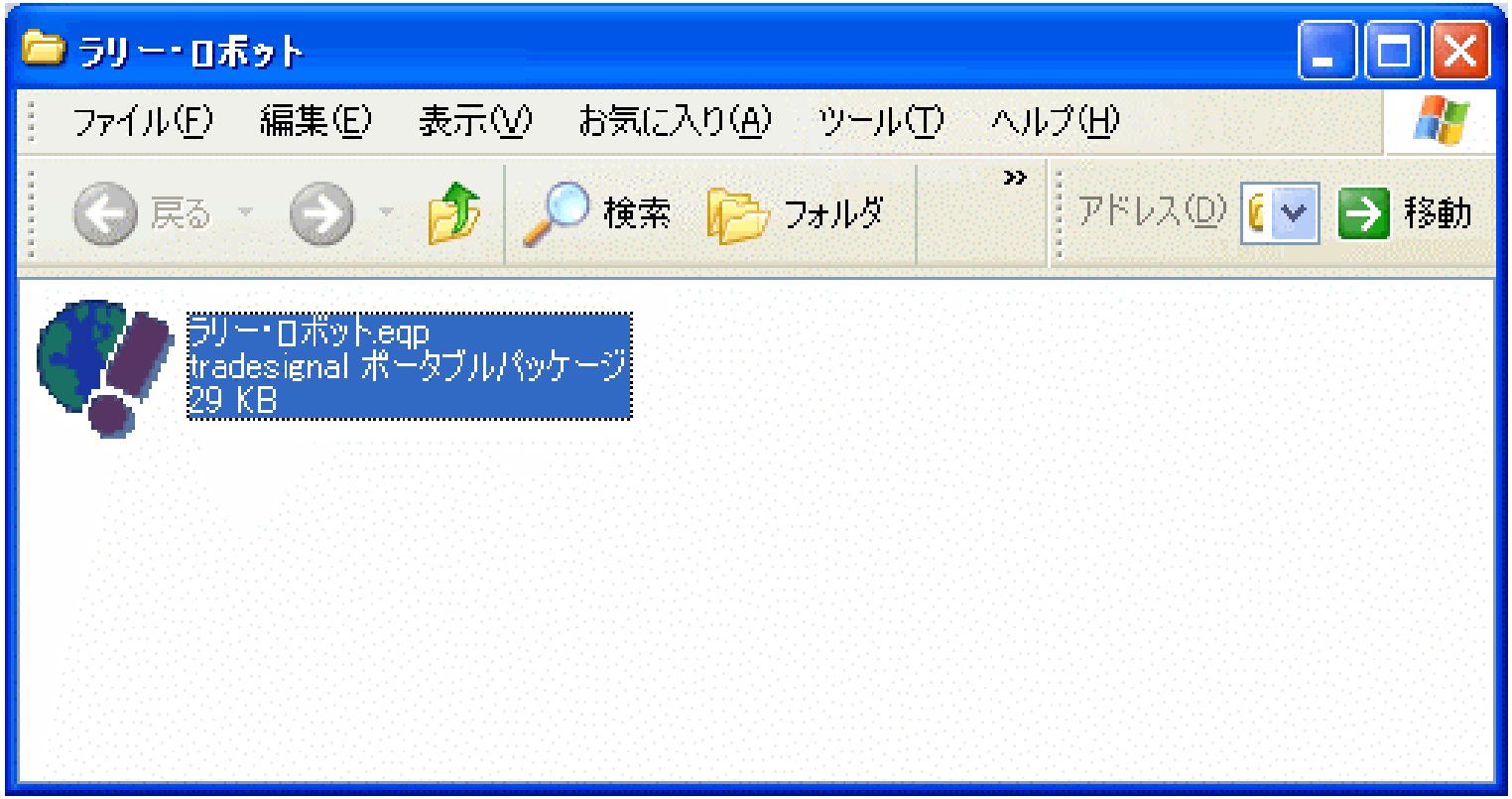
ラリー・ロボット５つの投資戦略

ラリー・ロボットにはラリー氏の投資戦略の中で、特にシステマチックな5つの投資戦略が収められています。

- ウップス
- 最高の売り
- GSV
- スペシャリストの罠
- スマッシュデイ

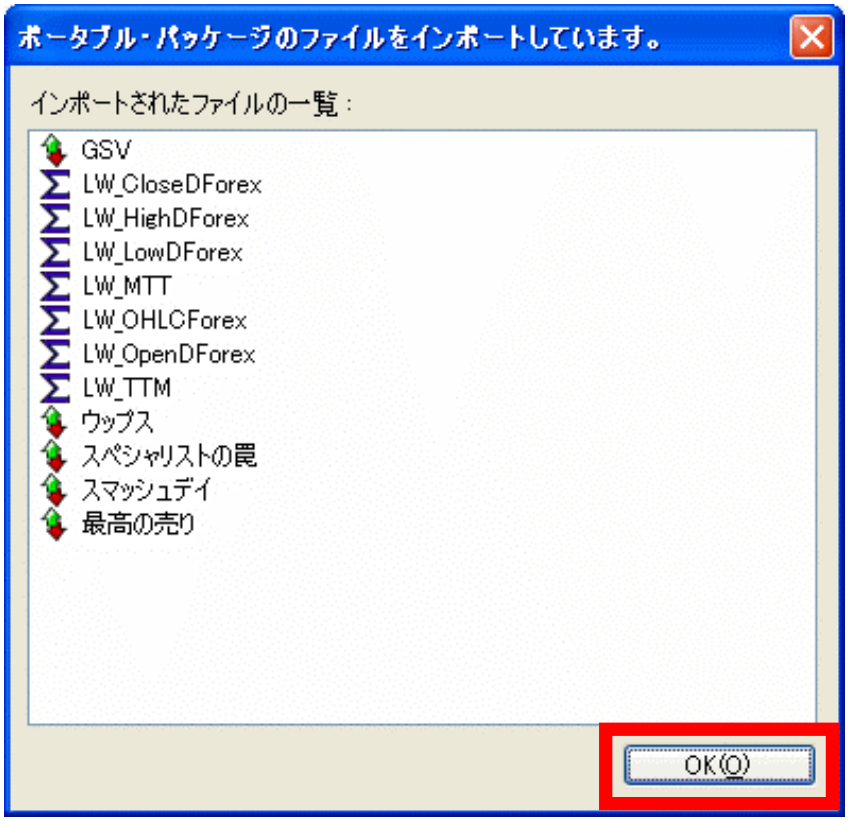
ラリーロボットの取り込み(1)

- ここではトレードシグナルを例に「ラリー・ロボット先物・株式版」の取り込み方を説明します。
- まず、トレードシグナルを起動している状態で、トレードシグナルのパッケージファイルアイコンをダブルクリックします。
- ＊注: 名前は下の画像と異なる場合があります。



ラリーロボットの取り込み(2)

- 下の画像のダイアログが現れます。パッケージの中には各投資戦略に関連するファイルが入っています。
- 「OK」をクリックします。
- ＊注: 名前は下の画像と異なる場合があります。

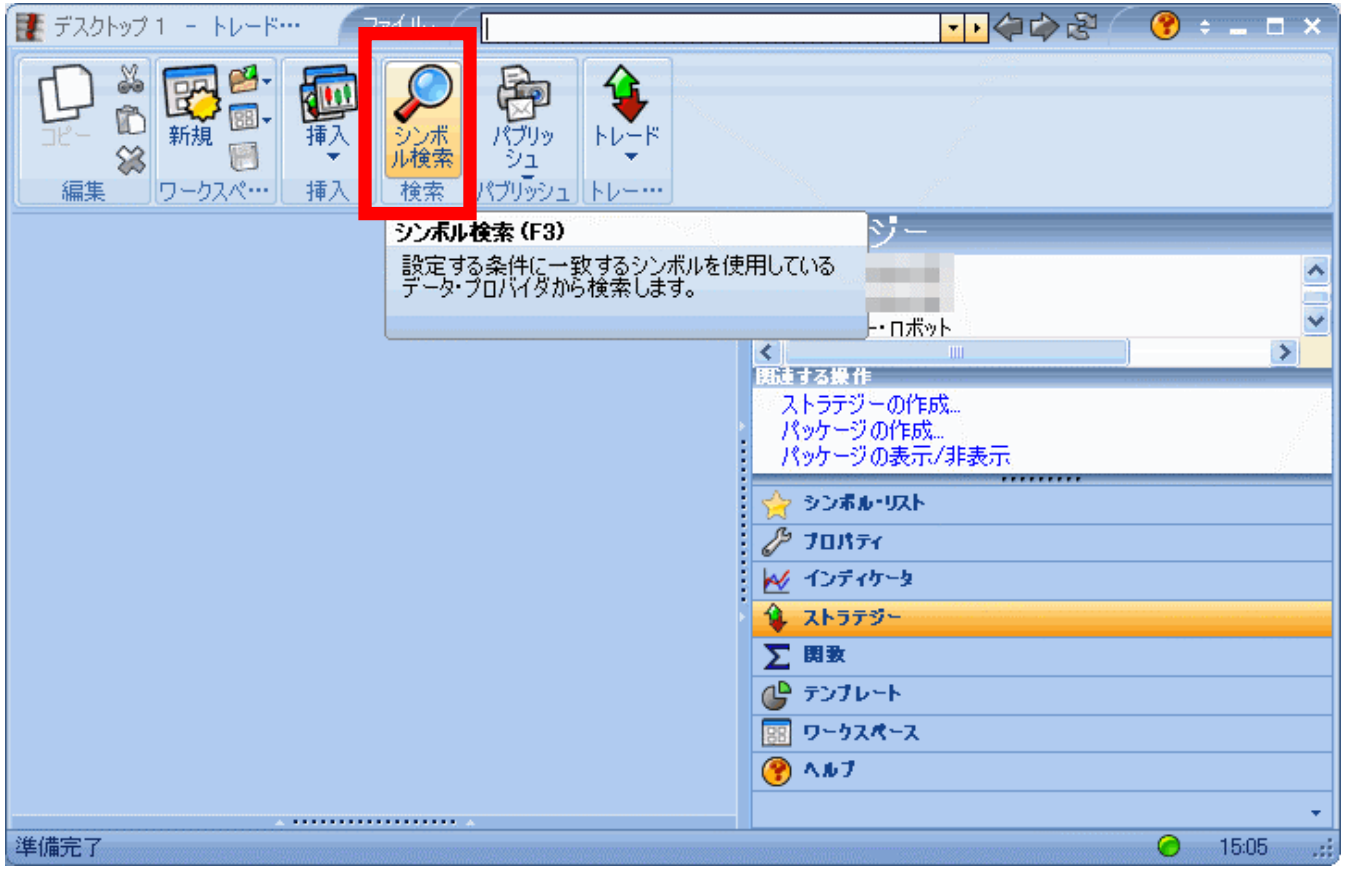


ラリーロボットの取り込み(3)

- 「ワークスペース」フォルダの中にパッケージファイルと同名のフォルダが作成され、中に各投資戦略に関連するファイルが入ります。
- これで取り込みは成功です。
- ＊注: 名前は下の画像と異なる場合があります。

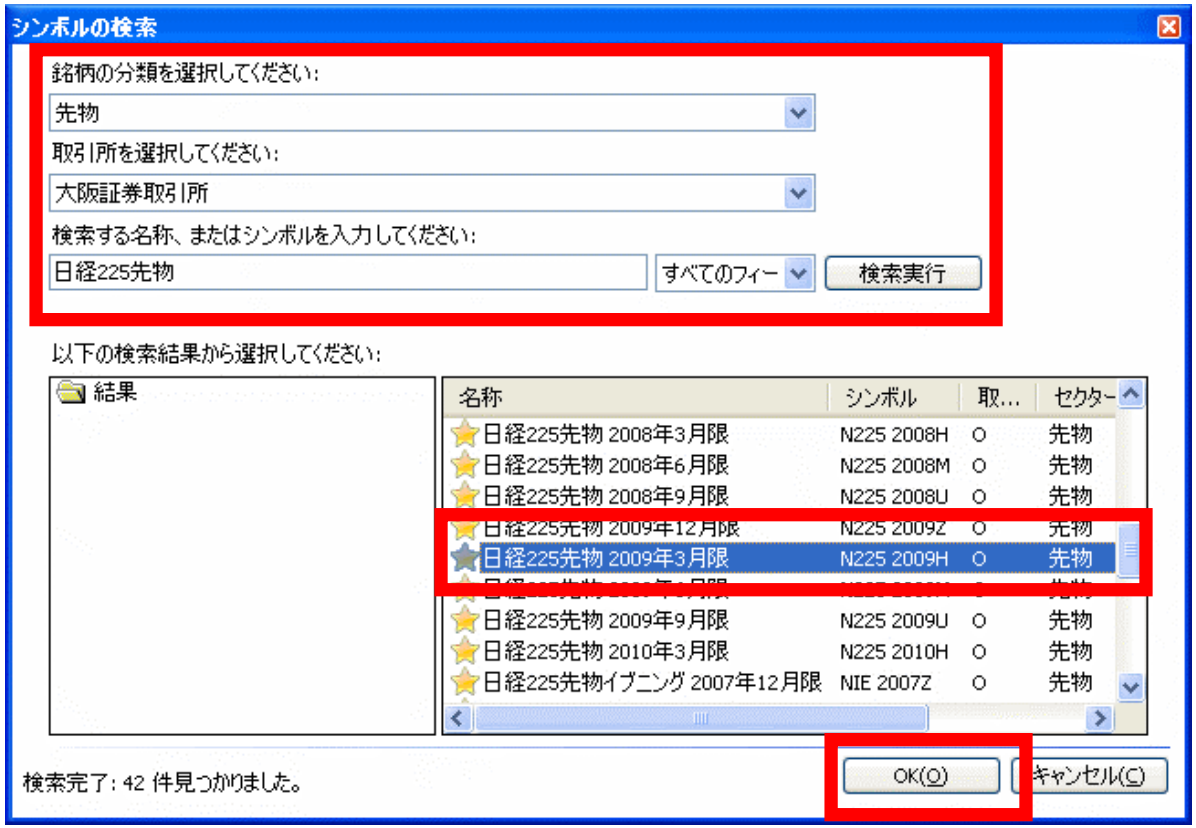
チャートを表示する -ラージ編(1)

- 上部「ツールバー」から「シンボル検索」を選択します。



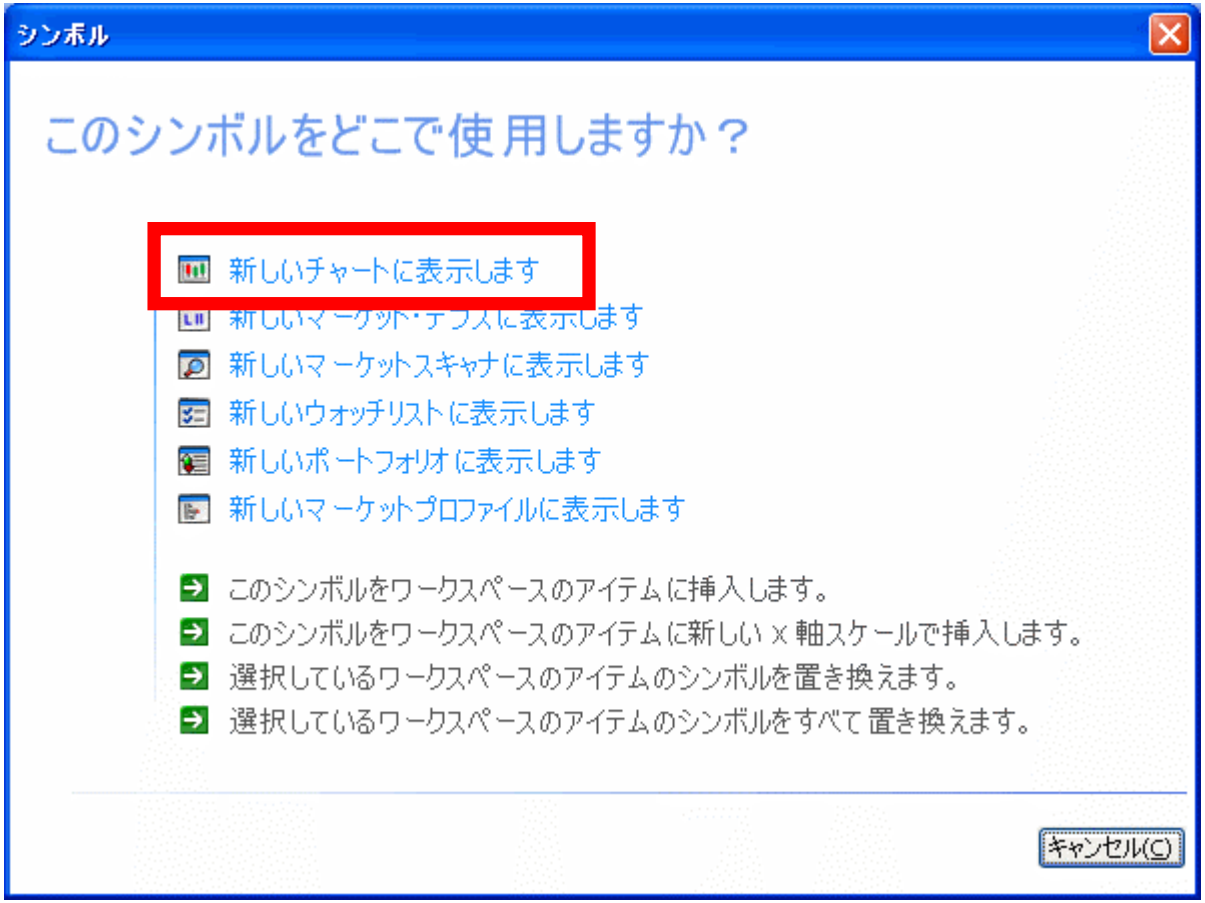
チャートを表示する -ラージ編(2)

- 「銘柄の分類を選択してください」で「先物」を、「取引所を選択してください」で「大阪証券取引所」を、「検索する名称、またはシンボルを入力してください」フィールドへ「日経225先物」と入力して「検索実行」ボタンを押します。
- 検索結果の中から現在の中心限月を選択して、「OK」をクリックします。



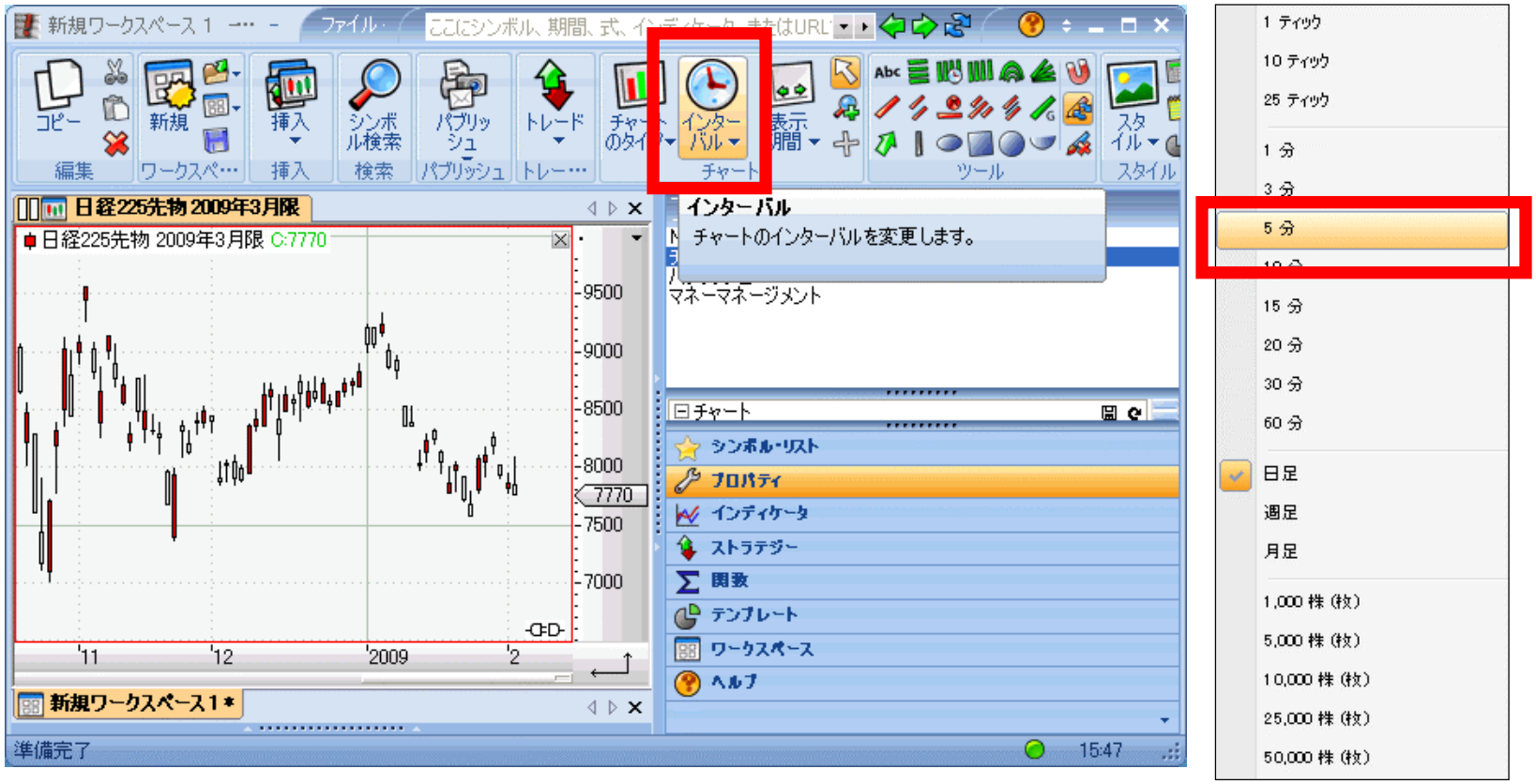
チャートを表示する -ラージ編(3)

- 「新しいチャートに表示します」を選択します。



チャートを表示する -ラージ編(4)

- チャートが作成されたら、「ツールバー」の「インターバル」をクリックして、メニューから「5分」を選択します。



チャートを表示する -ラージ編(5)

- チャートが5分足に変更されたら、「ツールボックス」から「ストラテジー」を選択した後、「ラリー・ロボット」の中の「ウップス」をダブルクリック、またはチャート上へドラッグ&ドロップします。

チャートを表示する -ラージ編(6)

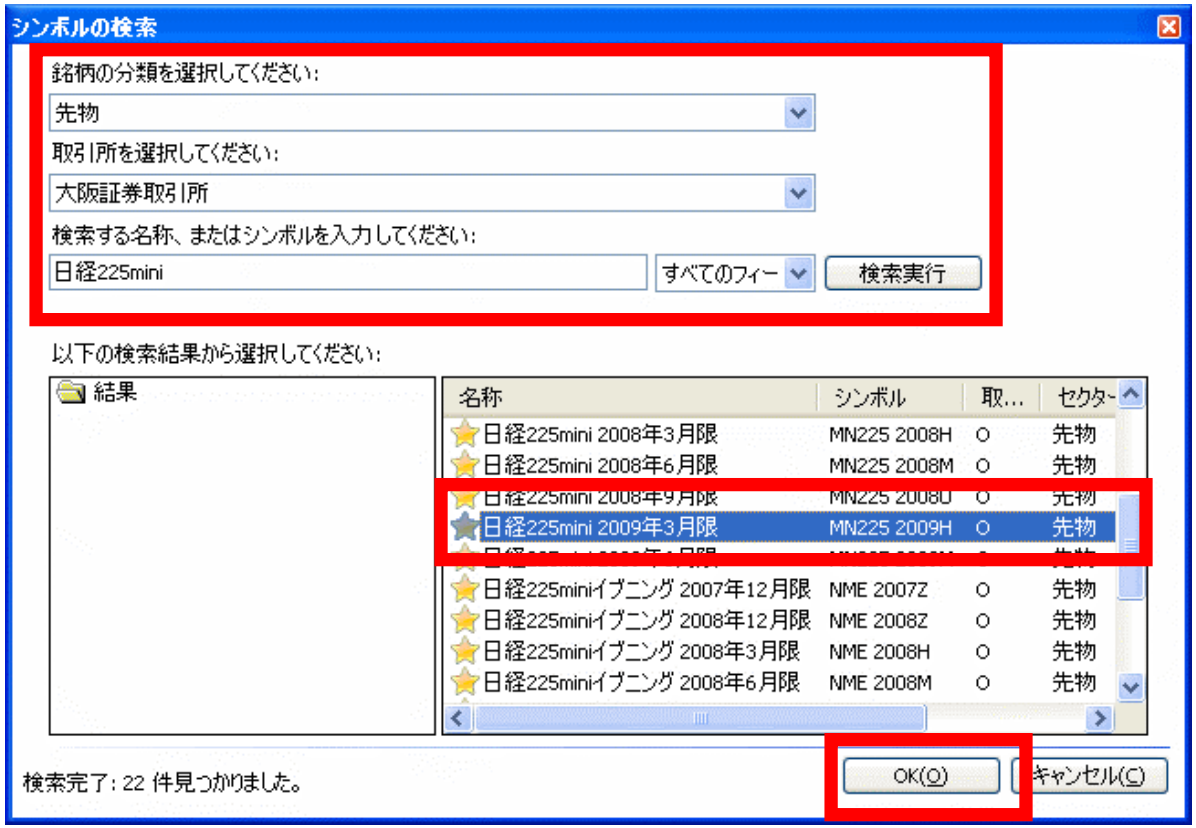
- チャート上に「ウップス 」が適用され、シグナルが表示されます。

チャートを表示する－ミニ編(1)

- 日経225先物チャートを日経225miniチャートに置き換えます。
- 上部「ツールバー」から「シンボル検索」を選択します。

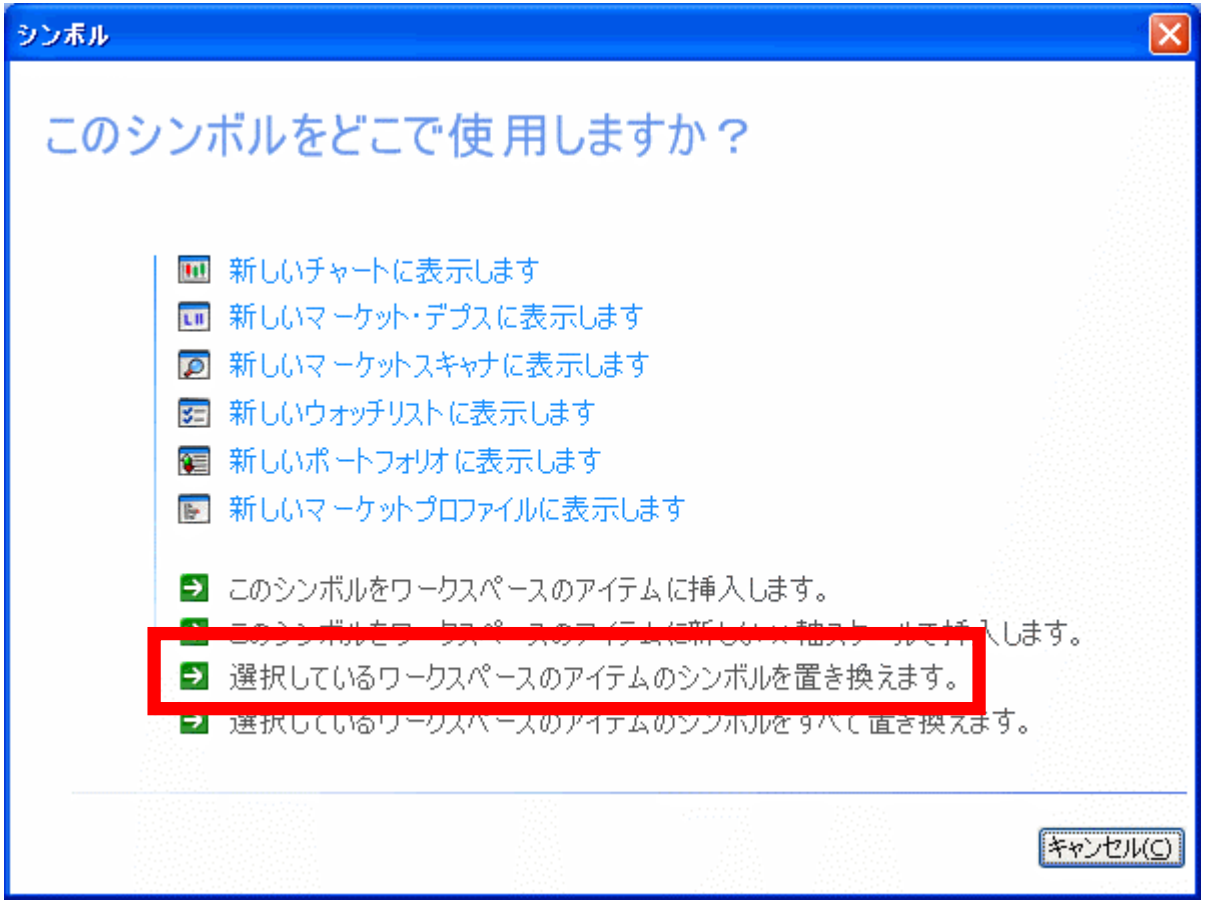
チャートを表示する－ミニ編(2)

- 「銘柄の分類を選択してください」で「先物」を、「取引所を選択してください」で「大阪証券取引所」を、「検索する名称、またはシンボルを入力してください」フィールドへ「日経225mini」と入力して「検索実行」ボタンを押します。
- 検索結果の中から現在の中心限月を選択して、「OK」をクリックします。



チャートを表示する –ミニ編(3)

- 「選択しているワークスペースのアイテムのシンボルを置き換えます」を選択します。



チャートを表示する－ミニ編(4)

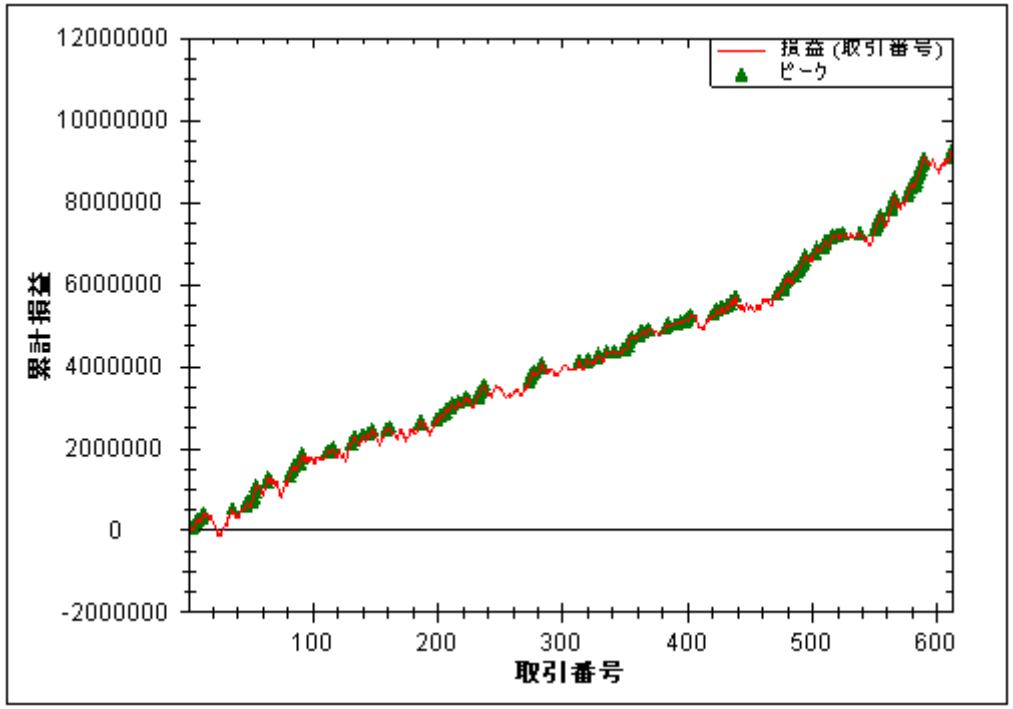
- 日経225先物チャートが日経225miniチャートに置き換わります。
- ＊注: 利益確定や損切りの標準設定は日経225先物の設定になっています。
  変更方法は後述します。

具体例 - ウップス

- 当日始値が前日安値より安く寄り付いた場合、前日安値の価格で買いの逆指値注文を出します。
- 当日始値が前日高値より高く寄り付いた場合、前日高値の価格で売りの逆指値注文を出します。

ウップスの損益グラフ

対象銘柄: 日経225先物 （ラージ）
検証期間: 1999年3月1日から2008年12月30日まで
設定詳細: 1枚で売買した結果です。手数料及びスリッページは含みません。
＊注: トレードシグナルでの検証結果です。



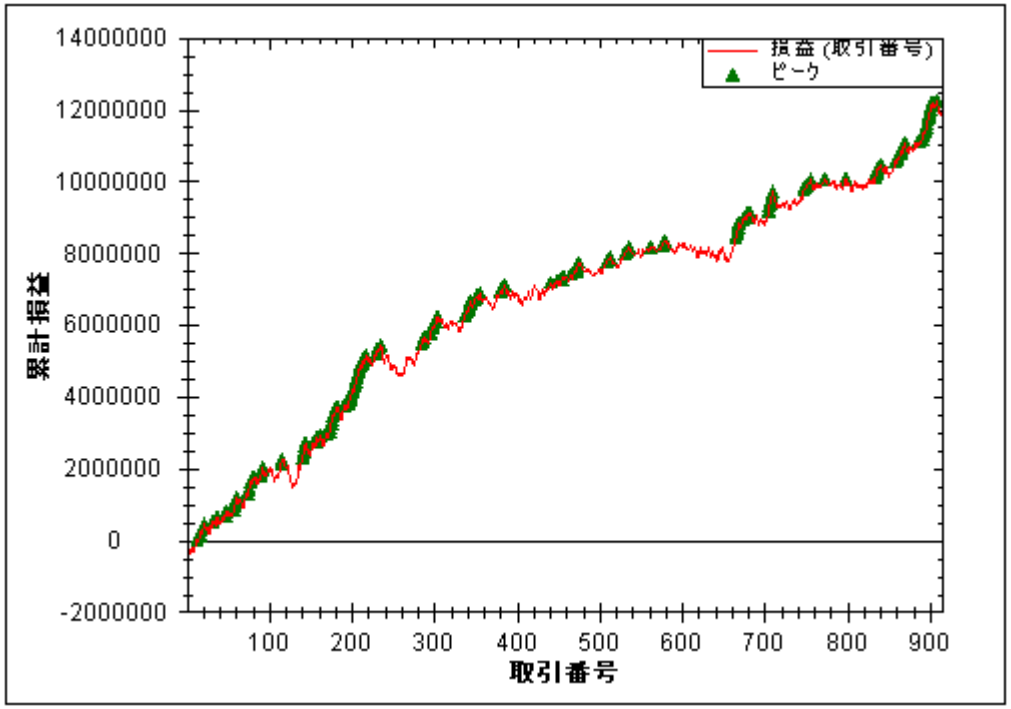
ウップスの統計要約

対象銘柄: 日経225先物 (ラージ)
検証期間: 1999年3月1日から2008年12月30日まで
設定詳細: 1枚で売買した結果です。手数料及びスリッページは含みません。
＊注: トレードシグナルでの検証結果です。

	全トレード	買いトレード	売りトレード
累計損益	9,320,000	4,570,000	4,750,000
トレード回数	612	289	323
勝率(%)	56.21	57.09	55.42
プロフィット・ファクター	1.51	1.49	1.54
損益レシオ	1.06	1.01	1.10
最大ドローダウン	600,000	750,000	540,000

最高の売りの損益グラフ

対象銘柄: 日経225先物（ラージ）
検証期間: 1999年3月1日から2008年12月30日まで
設定詳細: 1枚で売買した結果です。手数料及びスリッページは含みません。
＊注: トレードシグナルでの検証結果です。



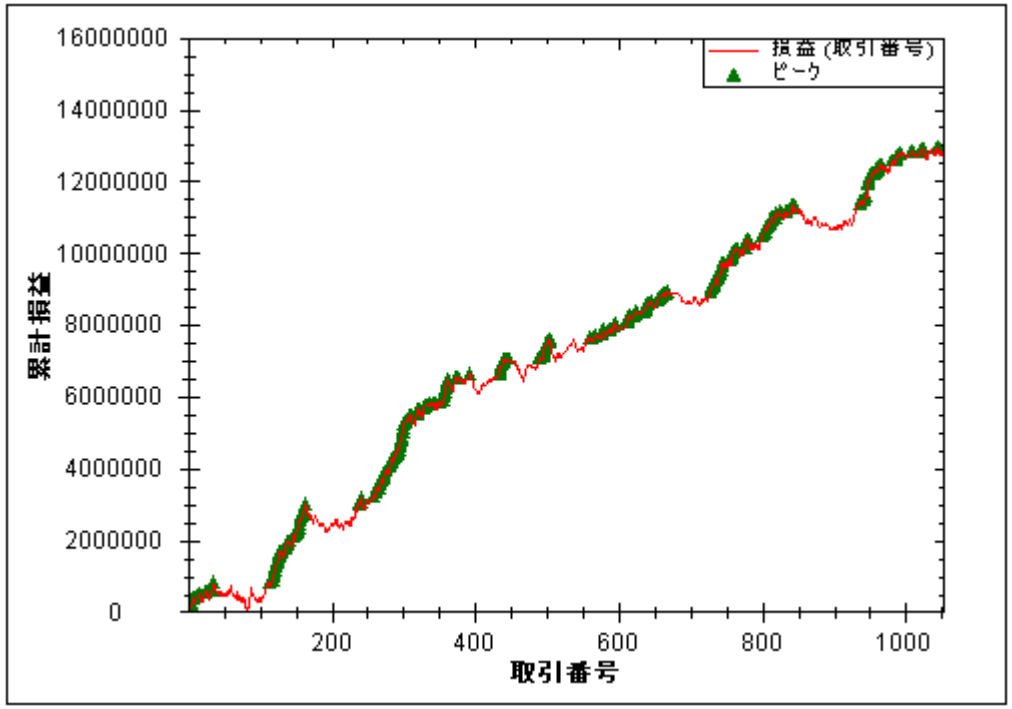
最高の売りの統計要約

対象銘柄: 日経225先物 (ラージ)
検証期間: 1999年3月1日から2008年12月30日まで
設定詳細: 1枚で売買した結果です。手数料及びスリッページは含みません。
＊注: トレードシグナルでの検証結果です。

	全トレード	買いトレード	売りトレード
累計損益	11,720,000		11,720,000
トレード回数	916		916
勝率(%)	55.35		55.35
プロフィット・ファクター	1.39		1.39
損益レシオ	1.05		1.05
最大ドローダウン	880,000		880,000

GSVの損益グラフ

対象銘柄: 日経225先物（ラージ）
検証期間: 1999年3月1日から2008年12月30日まで
設定詳細: 1枚で売買した結果です。手数料及びスリッページは含みません。
＊注: トレードシグナルでの検証結果です。



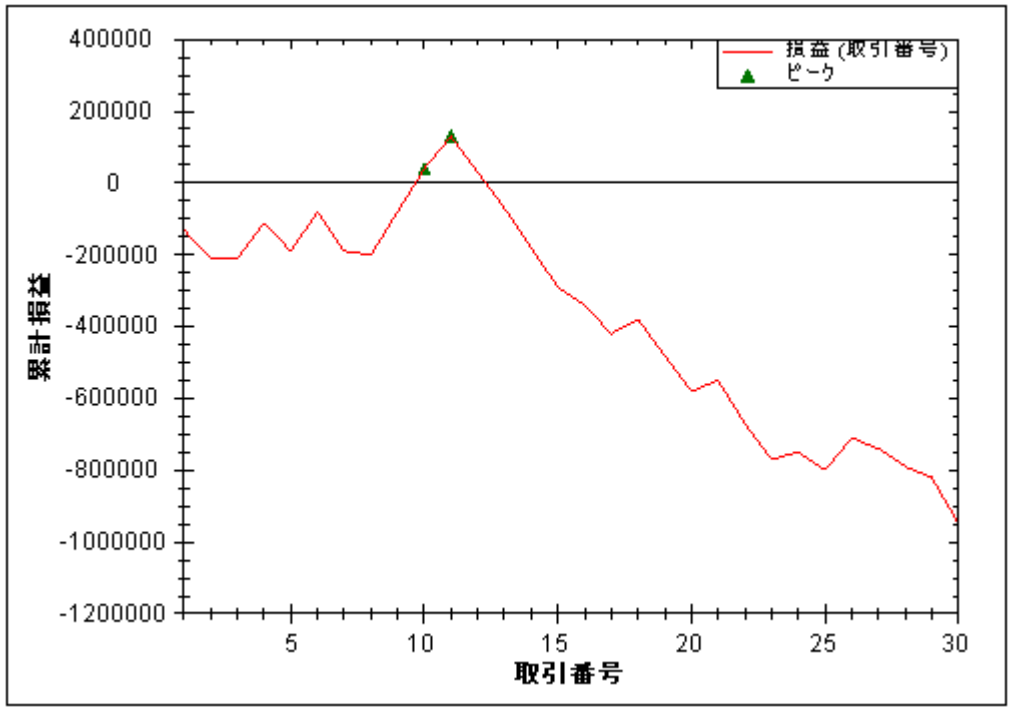
GSVの統計 要約

対象銘柄: 日経225先物 （ラージ）
検証期間: 1999年3月1日から2008年12月30日まで
設定詳細: 1枚で売買した結果です。手数料及びスリッページは含みません。
＊注: トレードシグナルでの検証結果です。

	全トレード	買いトレード	売りトレード
累計損益	12,560,000	6,730,000	5,830,000
トレード回数	1053	524	529
勝率(%)	53.18	54.77	51.61
プロフィット・ファクター	1.47	1.52	1.42
損益レシオ	1.14	1.09	1.19
最大ドローダウン	800,000	1,030,000	960,000

スペシャリストの罠の損益グラフ

対象銘柄: 日経225先物（ラージ）
検証期間: 1999年3月1日から2008年12月30日まで
設定詳細: 1枚で売買した結果です。手数料及びスリッページは含みません。
＊注: トレードシグナルでの検証結果です。



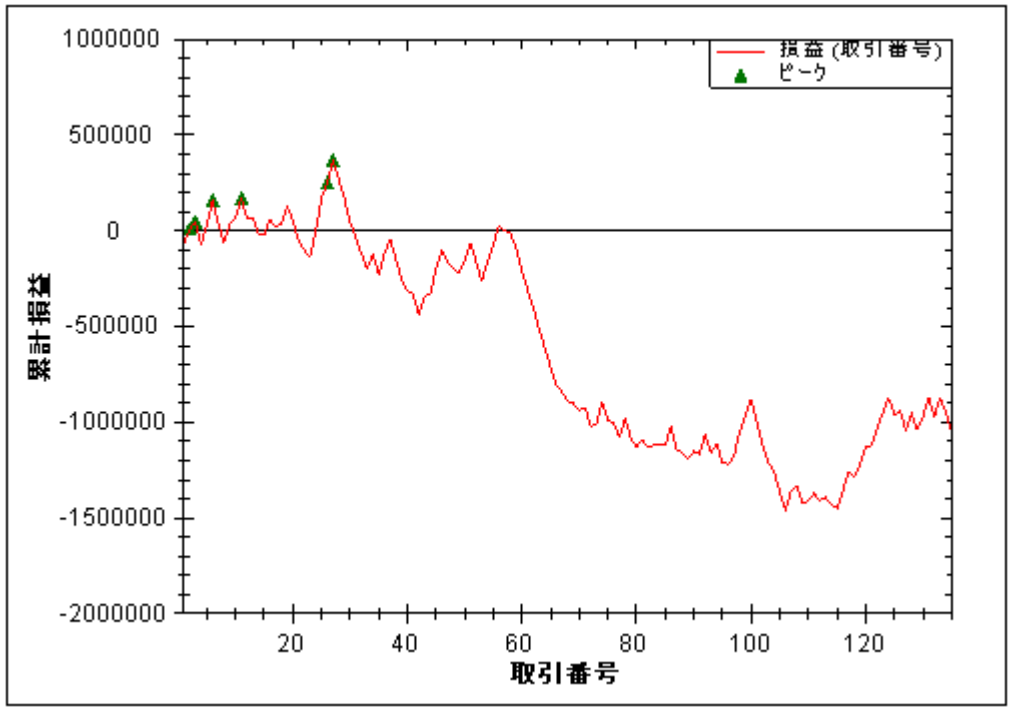
スペシャリストの罠の統計要約

対象銘柄: 日経225先物 （ラージ）
検証期間: 1999年3月1日から2008年12月30日まで
設定詳細: 1枚で売買した結果です。手数料及びスリッページは含みません。
＊注: トレードシグナルでの検証結果です。

	全トレード	買いトレード	売りトレード
累計損益	950,000	330,000	620,000
トレード回数	30	18	12
勝率(%)	30.00	33.33	25.00
プロフィット・ファクター	0.43	0.64	0.18
損益レシオ	0.96	1.17	0.55
最大ドローダウン	1,080,000	460,000	630,000

スマッシュデイの損益グラフ

対象銘柄: 日経225先物（ラージ）
検証期間: 1999年3月1日から2008年12月30日まで
設定詳細: 1枚で売買した結果です。手数料及びスリッページは含みません。
＊注: トレードシグナルでの検証結果です。



スマッシュデイの統計要約

対象銘柄: 日経225先物 （ラージ）
検証期間: 1999年3月1日から2008年12月30日まで
設定詳細: 1枚で売買した結果です。手数料及びスリッページは含みません。
＊注: トレードシグナルでの検証結果です。

	全トレード	買いトレード	売りトレード
累計損益	1,050,000	940,000	110,000
トレード回数	135	58	77
勝率(%)	42.96	37.93	46.75
プロフィット・ファクター	0.81	0.67	0.96
損益レシオ	1.02	1.04	1.04
最大ドローダウン	1,830,000	1,210,000	1,140,000

各種設定(1)–初期設定の概要

皆様が個々のローカル環境で自動売買を行いやすくするために、
ラリー・ロボットの5つの投資戦略の初期設定は下記のようになっています。
＊注1: ラリー・ロボット先物・株式版を基に説明しています。
＊注2: イブニング・セッションは含んでいません。

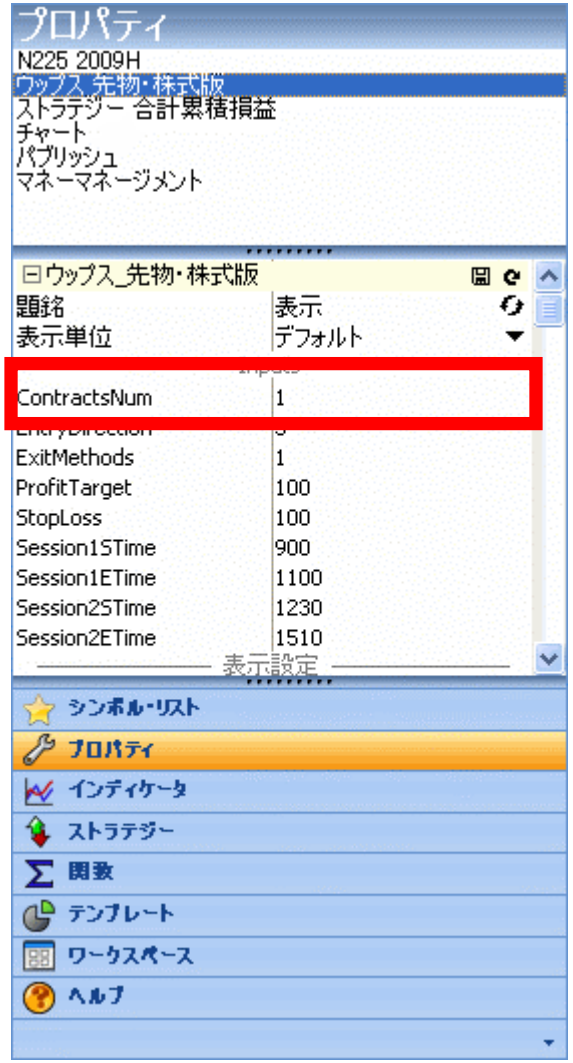
- 1トレードあたり1枚売買します。
- 「最高の売り」を除き、買いと売り両方を行います。
- 利益確定は100円、損切りは100円です。
- 利益確定または損切りに掛からなければ取引日の大引けで決済します。

各種設定(2)–初期設定の詳細

ラリー・ロボットの5つの投資戦略に共通する初期設定の詳細です。
＊注: ラリー・ロボット先物・株式版を基に説明しています。

- ContractsNum

  取引枚数を設定します。初期設定は「1」です。



各種設定(3)–初期設定の詳細

ラリー・ロボットの5つの投資戦略に共通する初期設定の詳細です。
＊注: ラリー・ロボット先物・株式版を基に説明しています。

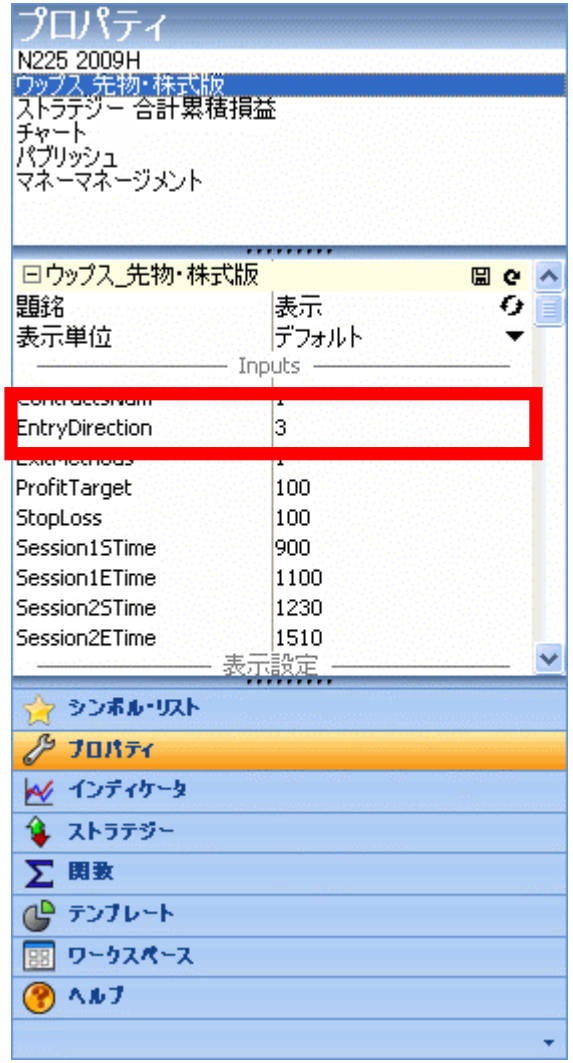
- EntryDirection

「1」にするとロングのみの売買シグナルが表示されます。

「2」にするとショートのみの売買シグナルが表示されます。

「3」にするとロング、ショートの両方の売買シグナルが表示されます。

初期設定は「3」です。



各種設定(4)–初期設定の詳細

ラリー・ロボットの5つの投資戦略に共通する初期設定の詳細です。
＊注1: ラリー・ロボット先物・株式版を基に説明しています。
＊注2: イブニング・セッションは含んでいません。

- ExitMethods

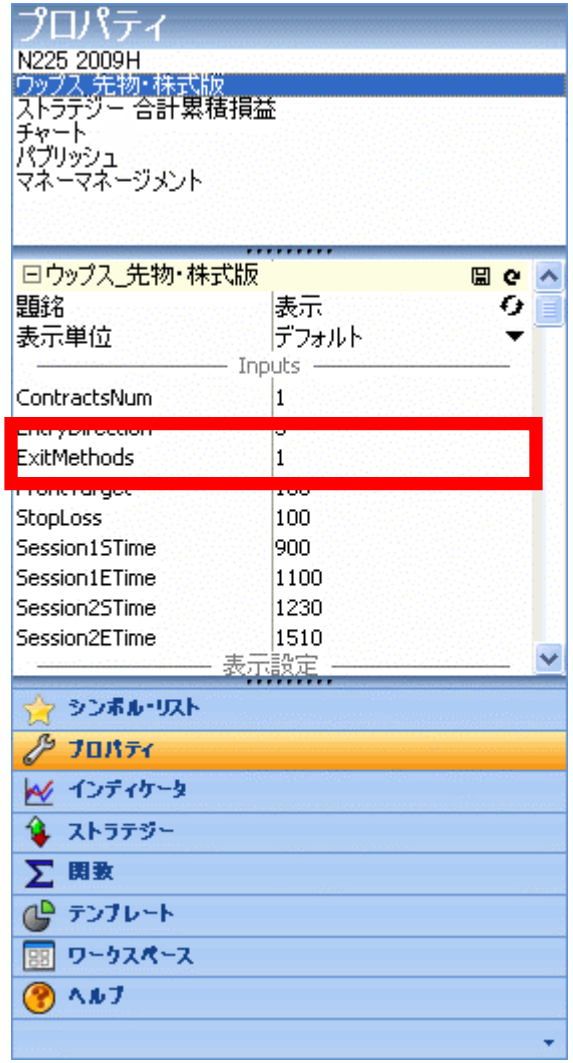
  「1」にするとエントリーがあった取引日の大引けで決済を行います。

  「2」にするとエントリー日の翌取引日の大引けで決済を行います。

  「3」にするとエントリー翌取引日の寄り付きで決済を行います。

  「4」にするとエントリーがあった取引日以降の含み益が出ている寄り付きで決済を行います。

  初期設定は「1」です。



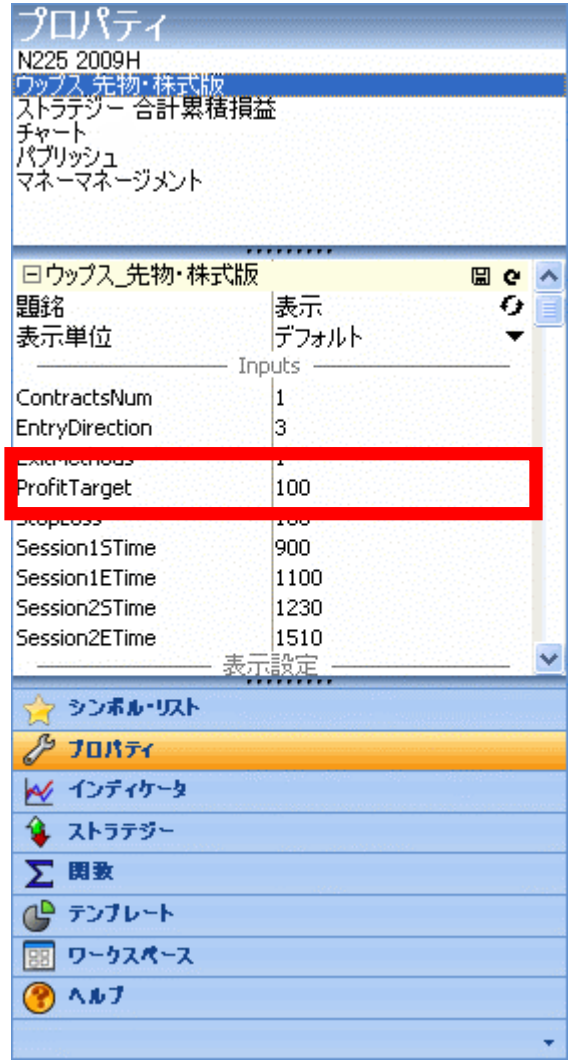
各種設定(5)–初期設定の詳細

ラリー・ロボットの5つの投資戦略に共通する初期設定の詳細です。
＊注: ラリー・ロボット先物・株式版を基に説明しています。

- ProfitTarget

  利益確定幅を呼値単位で指定します。条件を満たした足の終値で成行注文を出します。

  初期設定は「100」です。



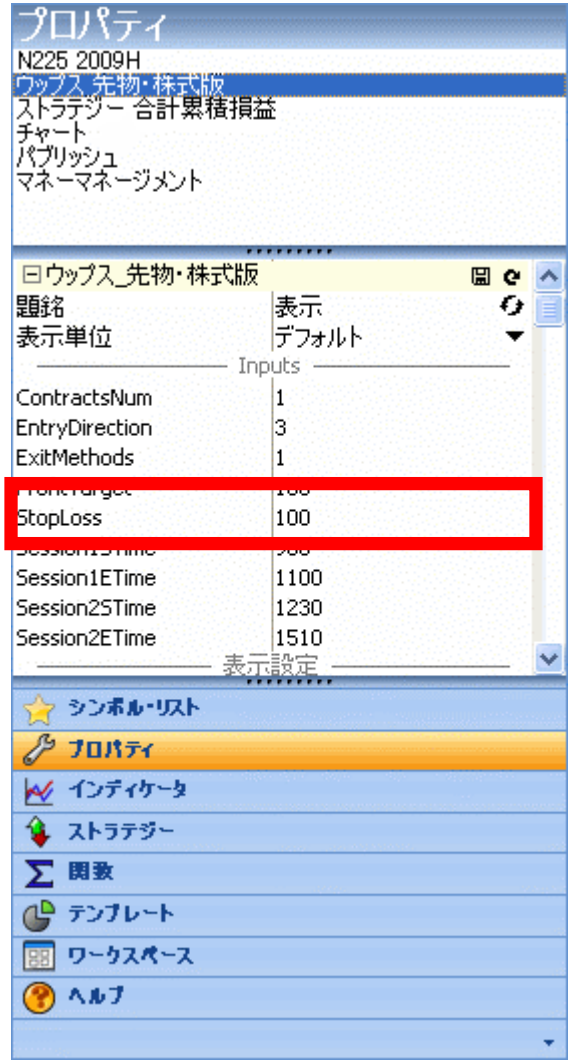
各種設定(6)–初期設定の詳細

ラリー・ロボットの5つの投資戦略に共通する初期設定の詳細です。
＊注: ラリー・ロボット先物・株式版を基に説明しています。

- StopLoss

  ロスカット幅を呼値単位で指定します。条件を満たした足の終値で成行注文を出します。

  初期設定は「100」です。



各種設定(7)–初期設定の詳細

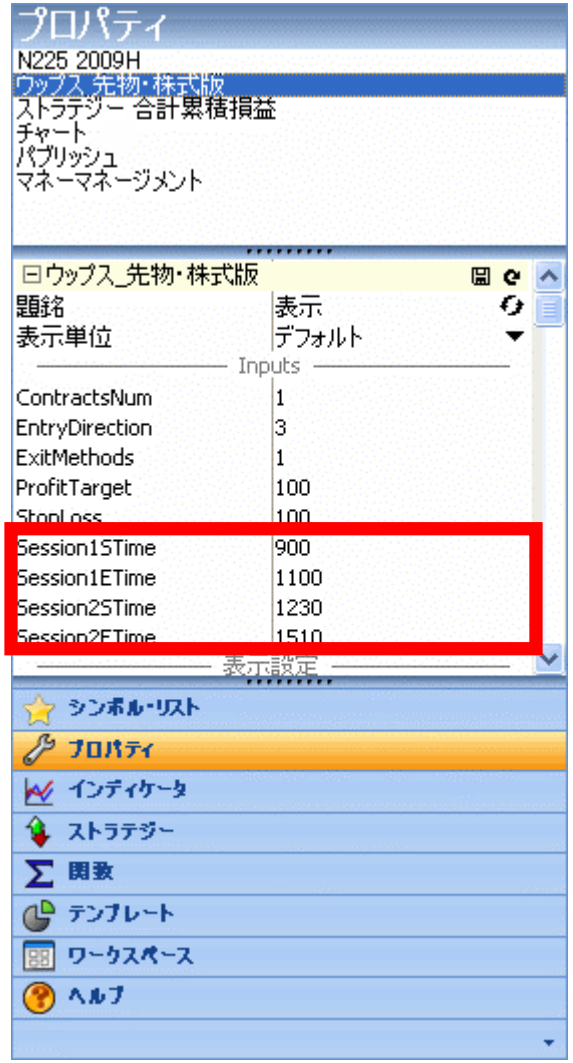
ラリー・ロボットの5つの投資戦略に共通する初期設定の詳細です。
＊注: ラリー・ロボット先物・株式版を基に説明しています。

- Sess1STime
  前場の寄付時間を指定します。
  初期設定は「900」、午前9時です。

- Sess1ETime
  前場の引け時間を指定します。
  初期設定は「1100」、午前11時です。

- Sess2STime
  後場の寄付時間を指定します。
  初期設定は「1230」、午後12時30分です。

- Sess2ETime
  後場の大引け時間を指定します。
  初期設定は「1510」、午後15時10分です。



各種設定(8)–ケース１

初期設定では、利益確定にも損切りにも掛からない場合、大引けで決済するようになっています。これを任意の時間へ変更することが可能です。

- 例えば、１４時に全てのポジションを決済したい場合、Sess2ETime を「1510」から「1400」へ変更します。

各種設定(8)–ケース２

利益確定は初期設定で100円です。これを任意の幅に変更することが可能です。

- 例えば、利益確定幅が100円で狭すぎると感じる場合、ProfitTargetを「100」から「200」へ変更します。

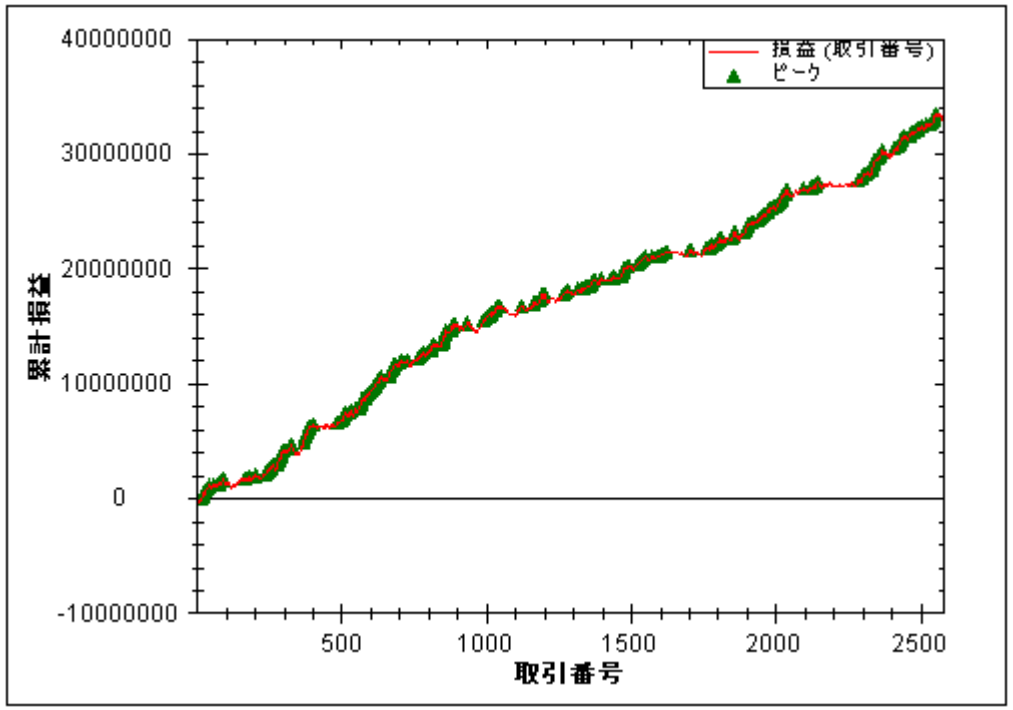
各種設定(8)–ケース３

損切りは初期設定で100円です。これを任意の幅に変更することが可能です。

- 例えば、損切り幅が100円で狭すぎると感じる場合、StopLoss を「100」から「200」へ変更します。

ポートフォリオ運用の損益グラフ

対象戦略: ウップス、最高の売り、GSVの3つのパフォーマンスを合算
対象銘柄: 日経225先物 （ラージ）
検証期間: 1999年3月1日から2008年12月30日まで
設定詳細: 1枚で売買した結果です。手数料及びスリッページは含みません。
＊注: トレードシグナルでの検証結果です。



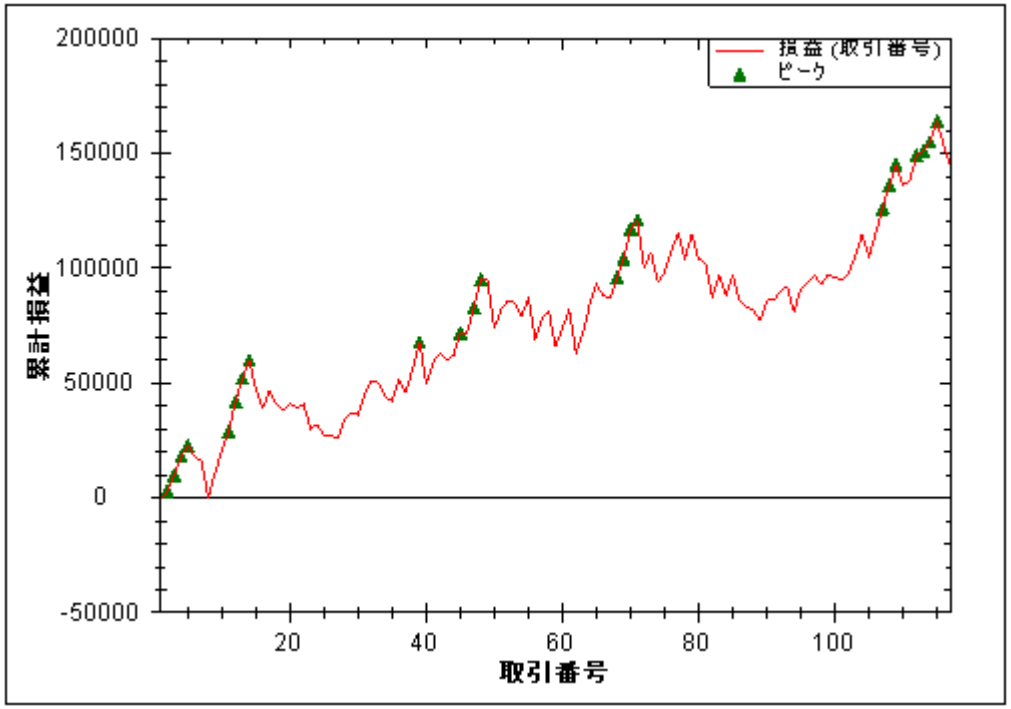
ポートフォリオ運用の統計要約

対象戦略: ウップス、最高の売り、GSVの3つのパフォーマンスを合算
対象銘柄: 日経225先物 （ラージ）
検証期間: 1999年3月1日から2008年12月30日まで
設定詳細: 1枚で売買した結果です。手数料及びスリッページは含みません。
＊注: トレードシグナルでの検証結果です。

	全トレード	買いトレード	売りトレード
累計損益	32,990,000	11,300,000	21,690,000
トレード回数	2581	813	1768
勝率(%)	56.63	55.60	54.19
プロフィット・ファクター	1.44	1.51	1.41
損益レシオ	1.08	1.06	1.09
最大ドローダウン	1,070,000	1,220,000	1,460,000

個別株への応用-損益グラフ

対象戦略: ウップス
対象銘柄: 5401　新日鉄
検証期間: 2006年12月14日から2008年12月30日まで
設定詳細: 1株で売買した結果です。手数料及びスリッページは含みません。利益確定は10円、損切りは20円です。
＊注: トレードシグナルでの検証結果です。



個別株への応用-統計要約

対象戦略: ウップス
対象銘柄: 5401　新日鉄
検証期間: 2006年12月14日から2008年12月30日まで
設定詳細: 1株で売買した結果です。手数料及びスリッページは含みません。利益確定は10円、損切りは20円です。
＊注: トレードシグナルでの検証結果です。

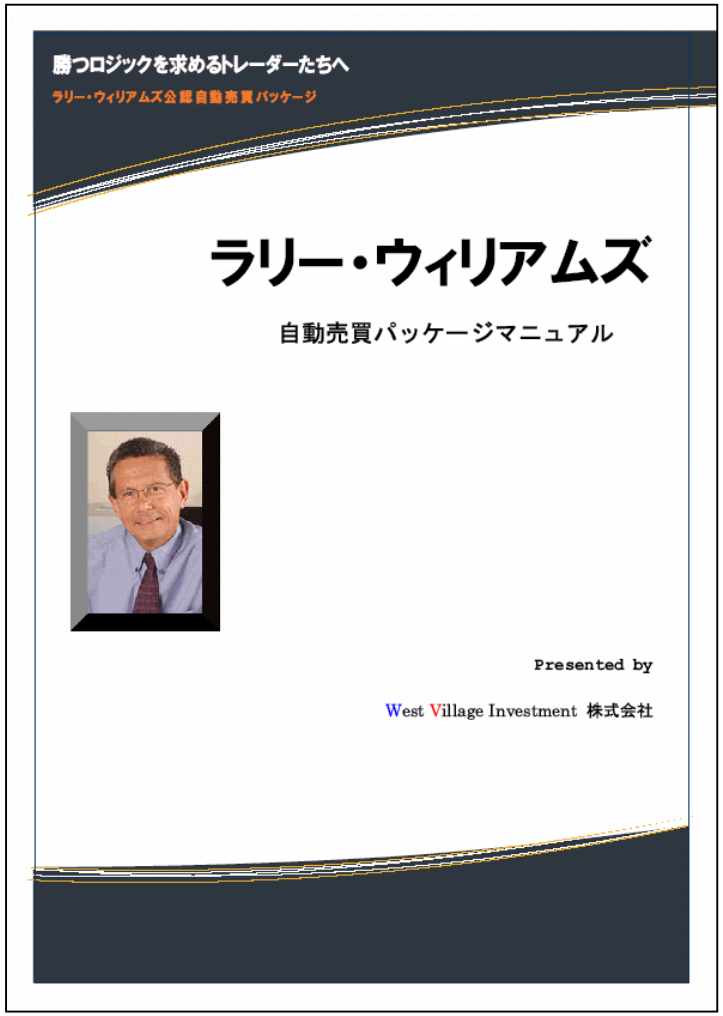
	全トレード	買いトレード	売りトレード
累計損益	144,000	4,400,000	100,000
トレード回数	117	60	57
勝率(%)	57.26	50.00	64.91
プロフィット・ファクター	1.41	1.21	1.68
損益レシオ	0.97	1.17	0.77
最大ドローダウン	44,000	52,000	58,000

ガイドブックの紹介(1)

- ラリー・ロボット購入者には5つの投資戦略の基本的な解説だけでなく、アドバンス的使い方の例を網羅した活用編も付いた「ラリー・ウィリアムズ自動売買パッケージ マニュアル」をプレゼントします。

- 購入前に「ラリー・ウィリアムズ自動売買パッケージマニュアル」の内容について興味がある方は下記URLにてガイドブックの一部を紹介している資料をダウンロードすることが可能です。

  http://www.wvi.jp/cat7/



ガイドブックの紹介(2)

ガイドブックにも載っている検証結果のほんの一部をご紹介！

- GSV（最大変動幅）の活用方法

  活用方法例①　TDW（Trading Day of Week：曜日のバイアス）の利用

  ラリー・ウィリアムズの手法の中で、特徴的なものの一つに
  “バイアス（その市場独特の傾向）”が挙げられる。
  その中で曜日ごとのバイアスを検証し、ある曜日が買い傾向にあるのか、
  売り傾向にあるのかを検証し、フィルターとして利用している。
  GSVに関しても、このTDWを利用して売買シグナルの取捨選択を行う方法
  が紹介されている。日経225先物を利用して曜日ごとのGSVの成績を検証し
  た結果が下図である。
  日経225先物（ラージ）を1枚売買した結果。手数料とスリッページは含まず。
  また、利益確定とロスカットは初期設定値100円で設定している。

ガイドブックの紹介(3)

対象戦略: ウップス
対象銘柄: 日経225先物 (ラージ)
検証期間: 1999年3月1日から2008年12月30日まで
設定詳細: 1枚で売買した結果です。手数料及びスリッページは含みません。
＊注: トレードステーション2000iでの検証結果です。

	全トレード	買いトレード	売りトレード
勝率(%)	65.20	72.81	55.56
プロフィット・ファクター	2.10	3.11	1.38
損益レシオ	1.12	1.16	1.10

ラリー・ロボット紹介ページ

- ラリー・ロボットについて更なる詳細は下記URLにて紹介しています。

http://www.wvi.jp/cat7/

免責事項

- 「ラリー・ロボット」（これに関するマニュアル、取扱説明書等などを含む。以下、当製品という。）は、West Village Investment株式会社（以下、当社という。）の製作、著作物です。当製品は、ラリー・ウィリアムズ氏が著書などで公開したロジックをプログラムコード化したものであり、その内容には正確性を期すよう努めておりますが、当製品の完全性を保証するものではありません。また、当社は、当製品の各プラットフォーム（投資戦略言語搭載可能なソフトウェア）上での動作確認はしておりますが、お客様固有の使用環境や通信ネットワーク環境での動作保証は行いません。当製品に関して如何なる品質保証はないことをご理解ください。
- 当製品のバックテスト結果は、当社所有の過去データに基づき計算した結果であり、将来の価格形成や運用利益を保証するものではございませんので、投資の意思決定は最終的にはお客様ご自身の判断でお願いいたします。
- 当製品の利用によって生じた損害（お客様固有のパソコン使用環境や通信ネットワーク環境によるもの、データ供給遅延などによるもの、証券会社などの発注システムによるものなど、損害の種類は問わない）や原状回復費用などに関して、当社は一切の責任を負いませんので予めご了承ください。

West Village Investment Co., Ltd.

【現物株式、株価指数先物取引、株価指数オプション取引に投資する場合の重要事項】

●株価の変動等により損失が生じるおそれがあります。

●株価指数先物取引、株価指数オプション取引の場合、取引金額が証拠金の額に比べて大きいため、その損失は証拠金の額だけに限定されません。

●株価指数先物取引・株価指数オプション取引の委託証拠金は、SPAN証拠金×120%ーネット・オプション・バリュー（NOV）の総額です。

●現物株式、株価指数先物取引、株価指数オプション取引の手数料においては紙面の都合上、記載できませんので弊社ホームページをご確認ください。

●契約締結前交付書面・口座約款等をよくお読みいただき、お取引の仕組み・ルールを十分にご理解のうえ、資産に合わせて、お客様ご自身の判断と責任において行っていただきますようお願い申し上げます。

ひまわり証券株式会社　関東財務局長（金商）第150号（金融商品取引業）
社団法人金融先物取引業協会、日本証券業協会

◆【ひまわりtradesignalの注意事項】

●「ひまわりtradesignal」（以下当ツールと言う）はシステムトレード（運用ルールに基づいてコンピューター・システムなどにより機械的に行う売買をいう）の手法を構築・検証することや、ご自身が設定した自動売買を行うことに利用できるツールです。

●当ツールは、上記に示したツールとしての利用提供を目的としており、金融商品の投資勧誘を目的としたものではなく、又将来の運用利益を保証するものではございません。投資の最終決定は、ご自身の判断でお願いいたします。

●当ツールは、ひまわり証券が正確性・確実性を期すように努めておりますが、完全性を保証するものではありません。
（また、予告なしに情報・内容を変更することがありますのでご注意ください。）

●当ツールの利用によって生じた損害（パソコンやネットワークに生じた損害を含み、損害の種類を問わない）やその修理費用等に関して、ひまわり証券は一切の責任を負いませんのでご了承ください。

ひまわり証券株式会社　関東財務局長（金商）第150号（金融商品取引業）
社団法人金融先物取引業協会、日本証券業協会

◆相場状況・分析等の投資情報、アナリストレポート又は関連する記載内容について

相場状況・分析等の投資情報、アナリストレポート又は、関連する記載内容は投資判断の参考となる情報の提供を目的としており、投資勧誘を目的としたものではありません。投資の最終決定は、ご自身の判断でお願いいたします。

相場状況・分析等の投資情報、アナリストレポート又は、関連する記載内容は、ひまわり証券が正確性、確実性を保証するものではありません。
(また、予告なしに変更することがありますのでご注意下さい。)

相場状況・分析等の投資情報、アナリストレポート又は、関連する記載内容によって生じたいかなる損害についても、弊社は一切の責任を負いません。

当レポートはひまわり証券のセミナー用の資料であり、その転載使用は一切認めません。

◇お問い合わせはこちら
ひまわり証券株式会社　http://sec.himawari-group.co.jp

関東財務局長(金商)第150号(金融商品取引業)
加入協会:社団法人金融先物取引業協会・日本証券業協会

フリーコール:0120-86-9686(08:00～18:00/土日祝日除く)